



TITLE:

ファジィ線形計画における双対定理(最適化の数理とその応用)

AUTHOR(S):

古川, 長太

CITATION:

古川, 長太. ファジィ線形計画における双対定理(最適化の数理とその応用). 数理解析研究所講究録 1993, 835: 244-250

ISSUE DATE:

1993-05

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/83436>

RIGHT:

ファジィ線形計画における双対定理

九大 理 古川 長太 (Nagata Furukawa)

1. ファジィ・ベクトルの空間における内積

shape function L に基づく L -ファジィ数の全体からなる集合を F_L で表す.

定義 1. 1 $A = (m, \alpha)_L$, $B = (n, \beta)_L$ を F_L の任意の 2 元, λ を任意の実数とし, それらの間の演算を次のように定義する.

$$(1) \quad A \oplus B = (m + n, \alpha + \beta)_L,$$

$$(2) \quad \lambda \cdot A = (\lambda m, \lambda \alpha)_L.$$

定義 1. 2 F_L におけるノルムを次式で定義する. すなわち $A = (m, \alpha)_L$ に対し

$$\|A\| = |m| + |\alpha|.$$

補題 1. 1 定義 1.1 の演算の下で, F_L は線形ノルム空間をなす.

定義 1. 3 F_L の 2 元の積を次式で定義する.

$$(m, \alpha)_L \otimes (n, \beta)_L = (mn + \alpha\beta, m\beta + \alpha n)_L.$$

補題 1. 2 $A, B, C \in F_L$, $r \in R$ に対し次の式が成り立つ.

$$(1) \quad A \otimes B = B \otimes A,$$

$$(2) \quad (A \oplus B) \otimes C = (A \otimes C) \oplus (B \otimes C),$$

$$(3) \quad A \otimes (r, 0)_L = r \cdot A,$$

$$(4) \quad (A \otimes B) \otimes C = A \otimes (B \otimes C),$$

$$(5) \quad A \otimes \theta = \theta.$$

shape function L を任意に与えた上で, F_L の元を成分とする p 次元ベクトルの空間を F_L^p で表す. F_L^p のベクトル間の和とベクトルのスカラー倍は, R^p の場合と同様に定義する. F_L^p におけるゼロベクトルを θ で表す. すなわち θ は各成分が F_L の零元 θ であるような p 次ベクトルである.

定義 1. 4 F_L^p の各 2 元 A, B に対して F_L の元 (A, B) が定まり, 次の

(I) ~ (IV) をみたすとき, (\cdot, \cdot) を F_L^p における内積と呼ぶ. ここで \leq は

Furukawaの定義によるL-ファジィ数間の半順序を表すものとする。

- (I) $(A, A) \succeq \theta \quad \forall A \in F_L^p$ かつ
 $(A, A) = \theta \iff A = \theta$,
- (II) $(A, B) = (B, A)$,
- (III) $(A+B, C) = (A, C) \oplus (B, C)$,
- (IV) $r \in R$ に対し, $(rA, B) = r(A, B)$.

$A = (A_1, A_2, \dots, A_p)$, $B = (B_1, B_2, \dots, B_p) \in F_L^p$ に対し

$$A \cdot B = \sum_{i=1}^p A_i \otimes B_i \quad (1.1)$$

で \cdot を定義する. ここで Σ は定義 1.1によるL-ファジィ数間の和 \oplus を表す.

補題 1.3 Lの零点 x_0 が $x_0 \leq 1$ をみたすとき, (1.1) で与えられた \cdot は, 内積の公理 (I) ~ (IV) をみたす.

2. ファジィ・ベクトルの空間における凸集合の分離定理

定義 2.1 $A, B \in F_L$ に対し

- (1) $A < B \stackrel{\text{def}}{\iff} A \leq B$ かつ $A \neq B$,
- (2) $A \frown B \stackrel{\text{def}}{\iff} A \not\leq B$ かつ $A \not\geq B$.

ファジィ数Aに対して, $\text{Inf}[A]$ と $\text{Sup}[A]$ を次で定義する.

$$\text{Inf}[A] = \inf(\text{Support}(A)), \quad \text{Sup}[A] = \sup(\text{Support}(A))$$

定義 2.2 $A, B \in F_L$ に対し,

- (a) $\text{Sup}[A] = \text{Sup}[B]$, (b) $\text{Inf}[A] = \text{Inf}[B]$,
- (c) $\text{Sup}[A] = \text{Inf}[B]$, (d) $\text{Inf}[A] = \text{Sup}[B]$,

のうちの少なくとも一つが成り立つとき, AとBは互いに隣接するという.

$A < B$ かつ AとBが互いに隣接するとき, これを記号で次のように表す.

$$A \underset{\text{adj}}{<} B$$

定理 2.1 Ω を F_L^D の空でない閉凸部分集合とし, F_L^D の点 Y を $Y \notin \Omega$ とする.
このとき

$$P \cdot X_0 > P \cdot Y \quad (2.1)$$

をみたす $X_0 \in \Omega$ および $P \in F_L^D$ ($P \neq \theta$) が存在して, 各 $X \in \Omega$ に対して次の

(1)~(4) のうちの少なくとも一つが成立する.

- (1) $P \cdot X \geq P \cdot X_0$,
- (2) $P \cdot X \sim P \cdot X_0$,
- (3) $(P \cdot X - P \cdot X_0) \sim \theta$,
- (4) $P \cdot X \underset{\text{adj}}{<} P \cdot X_0$.

系 2.1 定理 2.1において Ω を特に R^D の閉凸部分集合とすれば, R^D における通常の点と凸集合の強分離定理が導かれる.

3. ファジィ・ベクトルの空間における二者択一の定理

はじめに若干の定義と準備をする. 以後 shape function L の零点 x_0 は $x_0 < 1$ をみたすものとする.

$$B_L^+ \equiv \{ (m, \alpha)_L \in F_L \mid m > 0, |\alpha| \leq m \}$$

$$\bar{B}_L^+ \equiv B_L^+ \cup \{\theta\}$$

定義 3.1 $A = (m, \alpha)_L$, $B = (n, \beta)_L$ に対して

$$A \leqslant B \quad \stackrel{\text{def}}{\iff} \quad \begin{cases} |\alpha - \beta| \leq n - m & \text{if } \alpha\beta \geq 0 \\ |\alpha + \beta| \leq n - m & \text{if } \alpha\beta < 0 \end{cases}$$

補題 3.1 $A \leqslant B \implies A \leq B$

定義 3.2 $A = (m, \alpha)_L$, $B = (n, \beta)_L$ に対して

$$A \ll B \quad \stackrel{\text{def}}{\iff} \quad \begin{cases} n > m \text{ かつ } |\alpha - \beta| \leq n - m & \text{if } \alpha\beta \geq 0 \\ n > m \text{ かつ } |\alpha + \beta| \leq n - m & \text{if } \alpha\beta < 0 \end{cases}$$

定 義 3. 3 $A = (A_1, A_2, \dots, A_p), B = (B_1, B_2, \dots, B_p) \in F_L^p$ に対して

$$A \leqslant B \stackrel{\text{def}}{\iff} A_i \leqslant B_i \quad \text{for } i=1, 2, \dots, p$$

$$A \ll B \stackrel{\text{def}}{\iff} A_i \ll B_i \quad \text{for } i=1, 2, \dots, p$$

§ 2 で与えたファジィ・ベクトルの空間における凸集合の分離定理により, 次のような二者択一の定理が導かれる.

定 理 3. 1

A : 与えられた $q \times p$ ファジィ行列で成分はすべて L -ファジィ数

B : 与えられた $p \times 1$ ファジィベクトルで成分はすべて L -ファジィ数

とする. このとき

$$(I) \quad A^t Y = B, \quad Y \in (\bar{B}_L^+)^q$$

に解 Y があるか

$$(II) \quad AX \in (\bar{B}_L^+)^p$$

かつ次のいずれかが成立

$$(1) \quad B^t X < \theta$$

$$(2) \quad B^t X \sim \theta$$

$$(3) \quad \theta <_{\text{adj}} B^t X$$

に解 $X \neq \theta$ がある

のいずれか一方が必ず成立し, (I), (II) が共に成立することはない.

定 理 3. 2

A, B は定理 3.1 と同じとする. このとき

$$(III) \quad A^t Y - B \leqslant \theta, \quad Y \in (\bar{B}_L^+)^q$$

に解 Y があるか

$$(IV) \quad AX \in (\bar{B}_L^+)^q, \quad X \in (\bar{B}_L^+)^p$$

かつ次のいずれかが成立

$$(1) \quad B^t X < \theta$$

$$(2) \quad B^t X \cap \theta$$

$$(3) \quad \theta <_{\text{adj}} B^t X$$

に解 $X \neq \theta$ がある

のいずれか一方が必ず成立し、(Ⅲ), (IV) が共に成立するのはそれぞれの解 Y, X が

$$Y^t AX = \theta \quad (3.1)$$

をみたすときに限る.

定理 3.2 は完全な二者択一とは言えないが、(3.1) で表されるファジィ行列 A を介した直交条件を除外すればという意味で、殆ど二者択一であると言える.

4. ファジィ線形計画における双対定理

ファジィ線形計画の双対定理にはいろいろな型のものが考えられるが、ここでは最も簡単な型のものだけを与えておく.

A : 与えられた $p \times q$ ファジィ行列で成分はすべて L -ファジィ数

b : 与えられた $p \times 1$ 実ベクトル

c : 与えられた $q \times 1$ 実ベクトル

X : $q \times 1$ L -ファジィ変数ベクトル

Y : $p \times 1$ L -ファジィ変数ベクトル

として、次の2つの最適化問題を考える.

(P)

$$\begin{array}{l}
 \text{Max } c^t X \\
 \text{subject to} \\
 AX - b \leq \theta, \\
 X \in (\bar{B}_L^+)^q
 \end{array}$$

(D)

$$\begin{array}{l}
 \text{Min } b^t Y \\
 \text{subject to} \\
 A^t Y - c \geq \theta, \\
 Y \in (\bar{B}_L^+)^p
 \end{array}$$

上の2つの問題において、最大化と最小化はそれぞれ Furukawa の定義によるファジィ数間の半順序に関する最大化と最小化を意味する。

ここで2つの集合を定義する。

$$\Gamma \equiv \{X \in F_L^q \mid AX - b \leq \theta, X \in (\bar{B}_L^+)^q\}$$

$$\Delta \equiv \{Y \in F_L^p \mid A^t Y - c \geq \theta, Y \in (\bar{B}_L^+)^p\}$$

定理 4.1

$\Gamma \neq \emptyset$ かつ $\Delta \neq \emptyset$ ならば (P), (D) にそれぞれ最大解, 最小解 X_0, Y_0 が存在して,

$$c^t X_0 = b^t Y_0$$

が成立する。

あとがき：

完全な形の二者択一の定理は、ファジィ線形不等式の場合は一般には成立しないようである。しかし定理 3.2 のような殆ど二者択一の定理であれば、この定理の他に色々なタイプの定理を導くことが出来る。

双対定理に関しては、定理 4.1 は強すぎる仮定の下で最もシンプルな結果を導いたもので、試作品の域を出ない。検討、解決すべき問題が山積していることを付記しておく。